

# 银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金 基金产品资料概要更新

编制日期：2024-05-28

送出日期：2024-06-28

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	小盘价值	基金代码	159990
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	基金托管人	华泰证券股份有限公司
基金合同生效日	2019-12-06		
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所	2020-01-20	
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	交易型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
张亦驰	2021-05-25		2012-08-01
其他	场内简称:小盘价值 ETF		

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

详见本基金招募说明书(更新)的“基金的投资”章节。

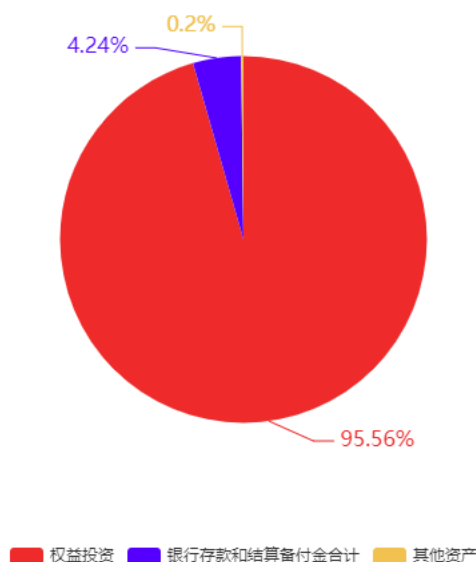
<b>投资目标</b>	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
<b>投资范围</b>	<p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金财产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p> <p>同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、衍生工具（股指期货、期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。</p> <p>本基金可以根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。</p>
<b>主要投资策略</b>	本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相

应调整。

<b>业绩比较基准</b>	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为巨潮小盘价值指数。
<b>风险收益特征</b>	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

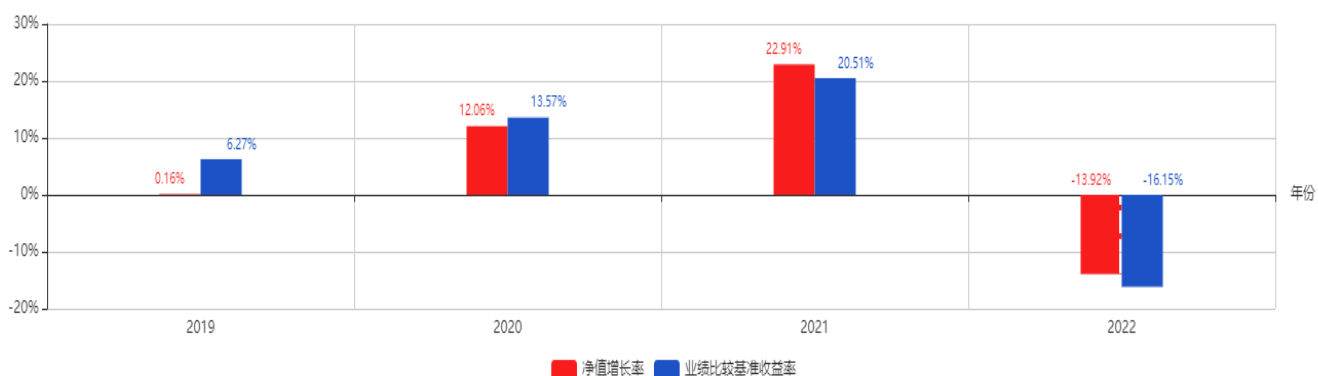
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表截止日为2023-06-30



## (三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：业绩表现截止日期 2022 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### 申购费，赎回费

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

**(二) 基金运作相关费用**

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	50,000.00元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00元	规定披露报刊
指数许可使用费	年费率0.03%，若当季日均基金资产净值大于5000万元时，当季费用下限为3.5万元，具体收费方式详见招募说明书。	指数编制公司
其他费用	其他费用详见本基金招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	相关服务机构

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费、信息披露费、指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

**(三) 基金运作综合费用测算**

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.21%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

**四、风险揭示与重要提示****(一) 风险揭示**

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金的特定风险包括：1、指数化投资的风险，本基金不低于90%的基金资产净值将用于跟踪标的指数，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。2、标的指数波动的风险，标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。4、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险，尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受供求关系等诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。5、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险，基金管理人或者基金管理人委托其他机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并由深圳证券交易所交易所在交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV计算也可能出现错误，投资人若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，需由投资人自行承担。6、基金份额赎回对价的变现风险，本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过

程中,由于市场变化、部分成份股流动性差等因素,导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异,存在变现风险。7、退市风险,因基金份额持有人大会决议提前终止上市,导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。8、提前终止基金合同风险,因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市,本基金将自动终止基金合同并进行基金财产清算,导致基金份额持有人无法继续投资本基金的风险。9、投资人申购失败的风险,本基金的申购赎回清单中,可能仅允许对部分成份股使用现金替代,因此,投资人在进行申购时,可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股,导致申购失败的风险。10、投资人赎回失败的风险,投资人在提出赎回申请时,如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价,可能导致赎回失败的情形。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。11、套利风险,由于证券市场的交易机制和技术约束,完成套利需要一定的时间,因此套利存在一定风险。同时,买卖一篮子股票和ETF存在冲击成本和交易成本,所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外,当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时,也会由于买不到成份股而影响溢价套利,或卖不掉成份股而影响折价套利。12、申购赎回清单差错风险,如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代保证金、替代金额等出错,将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。13、二级市场流动性风险,对ETF基金而言,二级市场流动性风险是指由于相关成份股的市场流动性不足使基金无法以合理价格买入或卖出所需股份数量所造成的风险。流动性风险主要发生在基金建仓期以及标的指数调整成份股期间。对ETF基金投资人而言,ETF可在二级市场进行买卖,因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题,带来基金在二级市场的流动性风险。14、第三方机构服务的风险,本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:1)申购赎回代理券商因多种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资人申购赎回服务的风险。2)登记机构可能调整结算制度,如对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化,制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。3)第三方机构可能违约,导致基金或投资人利益受损的风险。15、投资股指期货的风险,包括:(1)基差风险;(2)保证金风险;(3)合约展期风险。16、投资资产支持证券的风险,本基金投资资产支持证券,资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响,资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险。信用风险指的是基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。17、投资期权风险,包括:(1)流动性风险;(2)价格风险;(3)操作风险。18、参与融资交易的风险,包括:(1)杠杆效应放大风险;(2)担保能力及限制交易风险;(3)强制平仓风险。19、参与转融通证券出借业务的风险,本基金可参与转融通证券出借业务,面临的风险包括但不限于:(1)流动性风险;(2)信用风险;(3)市场风险。20、投资科创板股票的风险,包括:(1)市场风险;(2)流动性风险(3)信用风险;(4)集中度风险;(5)系统性风险;(6)政策风险。21、本基金的投资范围包括存托凭证,若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。22、跟踪误差控制未达约定目标的风险。23、指数编制机构停止服务的风险。24、成份股停牌风险。25、标的指数不再符合要求的风险。26、投资北京证券交易所股票的风险,包括:(1)上市公司经营风险;(2)股价大幅波动风险;(3)流动性风险;(4)转板风险;

(5) 退市风险；(6) 系统性风险；(7) 集中度风险；(8) 政策风险；(9) 监管规则变化的风险。

此外，本基金还将面临市场风险、基金运作风险、流动性风险等其他风险。

## (二) 重要提示

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同约定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。本基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)]；客服电话[400-678-3333、010-85186558]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

## 六、其他情况说明

无